

2024.04.22

短期利率

上週寬鬆因素有央行存單到期共 21,829.85 億元，緊縮因素有央行存單發行共 21,148.15 億，共減少發行 681.70 億元，上週存單到期量大，緊縮因素不多，整體市場資金狀況實屬寬鬆，在央行持續沖銷下，短期利率持平在區間內。30 天期自保票利率成交在 1.44%-1.54%，隔拆加權平均利率收在 0.809%，公債 RP 利率成交在 1.07%-1.15%。公司債 RP 利率成交在 1.40%-1.50%。

本週寬鬆因素有央行存單到期共 17,005.70 億元，緊縮因素有公債及公司債發行共 1,031.5 億元。本週除了公債外還有多檔公司債交割，以及有兩檔高股息基金募集，在整體市場資金充裕下，預計影響有限，短期利率仍將成交在區間內。預估本週隔夜拆款成交利率在 0.80%-0.85%，公債 RP 利率成交在 1.07%-1.15%，公司債 RP 利率成交在 1.40%-1.50%。

2024.04.22

公債交易

週五受到以色列對伊朗發動攻擊的消息下，美國公債亞洲盤殖利率一度大跌 10 b.p.，市場資金轉往避險性資產。使台債殖利率獲得喘息空間，十年期公債殖利率下跌 5.7 b.p.至 1.668%。

國外方面，儘管亞洲盤受中東局勢衝突帶動避險需求提升，但後續伊朗淡化衝突升級的影響，美國公債漲勢收斂，週五十年期公債殖利率微幅下跌 1.6 b.p.至 4.6166%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	4月18日	4月19日	漲跌(b.p.)
2年	A13101	1.4500	1.4500	+0.00
5年	A13105	1.5900	1.5900	+0.00
10年	A13107	1.7250	1.6680	-5.70
20年	A13102	1.5075	1.5075	+0.00
30年	A12111	1.7500	1.7500	+0.00